

К. Б. Сабитов

Институт прикладных исследований Академии наук РБ,

г. Стерлитамак,

sabitov_fmfi@mail.ru

ЛЕКЦИЯ: ПРИНЦИПЫ ЭКСТРЕМУМА РЕШЕНИЙ ЛИНЕЙНЫХ ДИФФЕРЕНЦИАЛЬНЫХ УРАВНЕНИЙ ВТОРОГО ПОРЯДКА

Интерес к принципам экстремума решений дифференциальных уравнений объясняется тем, что, во-первых, из них следует единственность и устойчивость решений краевых задач, а в свою очередь теорема единственности играет решающую роль при доказательстве существования решения краевой задачи методом интегральных уравнений. Во-вторых, они позволяют построить альтернирующий процесс типа Шварца для обоснования существования решения краевой задачи при довольно общих предположениях относительно данных задачи. В-третьих, принципы экстремума находят применение при построении спектральной теории краевых задач и установлении качественных свойств решений дифференциальных уравнений.

§1. Обыкновенные дифференциальные уравнения второго порядка

Рассмотрим в начале простейшее дифференциальное уравнение 2-го порядка

$$Lu \equiv u''(x) = 0, \quad x \in (a, b), \quad (1)$$

где $u(x)$ — неизвестная функция одной переменной x . Общее решение уравнения (1) имеет вид

$$u(x) = \alpha x + \beta, \quad \alpha, \beta \in \mathbb{R}. \quad (2)$$

Решение (2) на концах сегмента $[a, b]$ достигает своих наибольшего и наименьшего значений.

Если $\alpha \neq 0$, то $\max_{x \in [a, b]} u$ и $\min_{x \in [a, b]} u$ достигаются только на границе сегмента $[a, b]$ (см. рис. 1). Если $\alpha = 0$, то $u(x) \equiv \text{const} = \beta$ и $\max_{x \in [a, b]} u = \min_{x \in [a, b]} u = \beta$, и эти значения также достигаются на концах $[a, b]$.

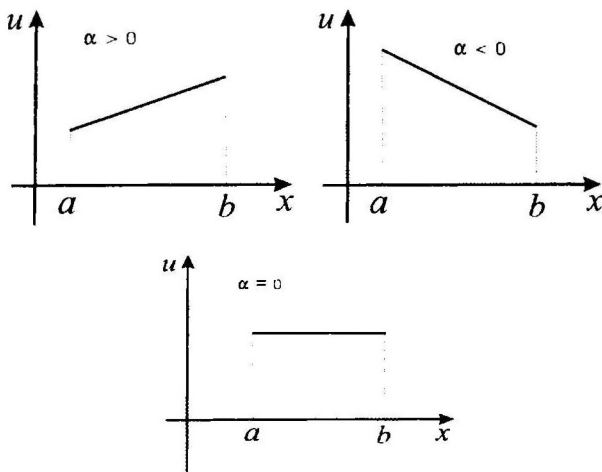


Рис. 1

Заметим, что

$$\text{при } \alpha > 0 : u'(a+0) < 0, u'(b-0) > 0;$$

$$\text{при } \alpha < 0 : u'(a+0) > 0, u'(b-0) < 0.$$

Теперь рассмотрим общее линейное дифференциальное уравнение второго порядка

$$Lu \equiv u''(x) + p(x)u'(x) + q(x)u = f(x), \quad a < x < b, \quad (3)$$

где $p(x)$, $q(x)$, $f(x)$ — заданные на $[a, b]$ непрерывные функции.

Теорема 1 (Внутренний принцип экстремума).

I. Если всюду на (a, b)

$$q(x) < 0 \quad \text{и} \quad f(x) \geq 0 \quad (f(x) \leq 0) \quad (4)$$

или

$$q(x) \leq 0 \quad \text{и} \quad f(x) > 0 \quad (f(x) < 0), \quad (5)$$

то любое решение $u(x)$ уравнения (3) не может иметь на (a, b) точек положительного (отрицательного) локального максимума (минимума).

II. Если всюду на (a, b)

$$q(x) \leq 0 \quad \text{и} \quad f(x) \geq 0 \quad (f(x) \leq 0), \quad (6)$$

то любое решение $u(x)$ уравнения (3) на (a, b) не может иметь точек положительного (отрицательного) локального максимума (минимума), когда оно не обращается в постоянную на (a, b) .

Если в обоих случаях решение $u(x)$ непрерывно на $[a, b]$, то наибольшее (наименьшее) положительное (отрицательное) на $[a, b]$ значение $u(x)$ достигается только на концах этого сегмента.

Отметим, что во второй части теоремы 1 условия (4) и (5) объединены в условия (6), но при этом появляется дополнительное условие, что решение уравнения (3) не обращается в постоянную на интервале (a, b) .

Теорема 2 (Граничный принцип экстремума). Пусть:

- 1) $q(x) \leq 0$ и $f(x) \geq 0$ (≤ 0) на (a, b) ;
- 2) $u(x)$ — отличное от постоянной решение уравнения (3) из класса $C^1[a, b]$;
- 3) $\max_{[a, b]} u(x) = u(x_0) > 0$ ($\min_{[a, b]} u(x) = u(x_0) < 0$).

Тогда $u'(b-0) > 0$ (< 0), если $x_0 = b$ и $u'(a+0) < 0$ (> 0), если $x_0 = a$.

Доказательство теорем 1 и 2 приводится в [1, гл. 3, §10].

Теперь покажем применение теорем 1 и 2 на следующем примере.

Пример 1. Пусть в классе $C^1[a, b]$ существует решение $u(x)$ уравнения (3), где $q(x) \leq 0$ и $q(x) \neq 0$, удовлетворяющее одному из граничных условий:

а) $u(a) = u_0$, $u(b) = u_1$ (первая граничная задача);

б) $u'(a) = u_0$, $u'(b) = u_1$ (вторая граничная задача);

в) $\alpha_1 u(a) - \beta_1 u'(a) = u_0$, $\alpha_2 u(b) + \beta_2 u'(b) = u_1$ (третья граничная задача), где α_i , β_i — заданные действительные числа одного знака, $i = 1, 2$, u_0 , u_1 — заданные действительные числа. Доказать, что такое решение единственно.

Решение. Пусть существует два решения $u_1(x)$ и $u_2(x)$ уравнения (3), удовлетворяющих одним и тем же граничным условиям на концах $[a, b]$. Рассмотрим их разность $u_1(x) - u_2(x) = u(x)$, которая удовлетворяет однородному уравнению $L(u) = 0$ и нулевым граничным условиям (т. е. $u_0 = u_1 = 0$, $f(x) \equiv 0$).

Докажем, что $u(x) \equiv 0$ на (a, b) . Пусть $u(x) \not\equiv 0$ на (a, b) , т. е. существует $x' \in (a, b)$, такая, что $u(x') \neq 0$. Пусть для определенности $u(x') > 0$. Тогда $\max_{[a, b]} u(x) = u(x_0) > 0$, $x_0 \in [a, b]$. Поскольку $q(x) \leq 0$ и $f(x) \equiv 0$ на (a, b) , то в силу теоремы 1 значение $u(x_0)$ достигается только на концах сегмента $[a, b]$, т. е. в точках a и b при условии, что $u(x) \neq \text{const}$.

В случае а) $u(x_0) = u(a) = 0$ или $u(x_0) = u(b) = 0$, чего быть не может. Следовательно, $u(x) \equiv \text{const} = C_0$ на $[a, b]$. По условию функция $u(x)$ непрерывна на $[a, b]$ и $u(a) = u(b) = 0$, тогда $u(x) \equiv C_0 = 0$.

Пусть выполнены условия б). В этом случае в силу теоремы 2 $u'(a+0) < 0$ при $x_0 = a$ или $u'(b-0) > 0$ при $x_0 = b$, которые противоречат условию $u'(a) = u'(b) = 0$. Тогда $u(x) \equiv \text{const} = C_0$. Подставив $u(x) \equiv C_0$ в уравнение (3) (где $f(x) \equiv 0$), получим $q(x) \cdot C_0 \equiv 0$. Отсюда следует, что $C_0 = 0$, так как $q(x) \not\equiv 0$ на (a, b) .

Пусть выполнены условия в). Тогда, если $x_0 = a$, то $u'(a) = u(a)\alpha_1/\beta_1 > 0$, что в силу теоремы 2 противоречит $u'(a) < 0$; если же $x_0 = b$, то $u'(b) = -u(b)\alpha_2/\beta_2 < 0$, которое несовместимо с неравенством $u'(b) > 0$.

Таким образом, во всех трех случаях $u(x) \equiv 0$ на (a, b) . Отсюда в силу непрерывности $u(x)$ на $[a, b]$ следует, что $u(x) \equiv 0$ на $[a, b]$.

Отметим, что в случае б), если $q(x) \equiv 0$ на (a, b) , то $u(x) \equiv \text{const}$ на $[a, b]$.

На студенческих олимпиадах по математике предлагались следующие примеры.

Пример 2. Пусть $y(x) \in C[0, 1] \cap C^2(0, 1)$, $y(0) = y(1) = 0$, $y'' = e^x y$; доказать, что $y(x) \equiv 0$.

Пример 3. Доказать, что задача $y'' - x^2 y = 0$, $-1 < x < 1$, $y(-1) = y(1) = 0$, имеет только нулевое решение.

§2. Уравнение Лапласа. Гармонические функции

Рассмотрим уравнение Лапласа

$$\Delta u(x) = \sum_{i=1}^n \frac{\partial^2 u(x)}{\partial x_i^2} = 0 \quad (7)$$

в ограниченной области $D \subset \mathbb{R}^n$ (см. рис. 2) точек $x = (x_1, x_2, \dots, x_n)$, $n \geq 2$.

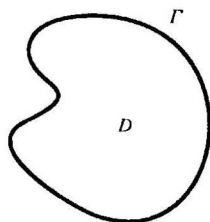


Рис. 2

Определение 1. Функция $u(x)$ называется гармонической в D , если $u(x) \in C^2(D)$ и $\Delta u(x) \equiv 0$ в D .

Теорема 3 (Внутренний принцип экстремума). Если функция $u(x)$ является гармонической в ограниченной области D , непрерывной на замкнутой области $\bar{D} = D \cup \Gamma$ и отличной от постоянной, то наибольшее и наименьшее значения этой функции по \bar{D} не могут достигаться внутри области D , т. е. эти значения достигаются только на границе Γ .

Следствие 1. Если функция $u(x)$ является гармонической в области D , непрерывной в замкнутой области \bar{D} и наибольшее (наименьшее) значение по \bar{D} достигает внутри области D , то она постоянна в \bar{D} .

Следствие 2. Если функция $u(x)$ является гармонической в области D , непрерывной на \bar{D} и $u(x) \geq 0$ на Γ , то $u(x) \geq 0$ в \bar{D} .

Следствие 3 (Свойство сравнения). Если функции $u(x)$ и $v(x)$ являются гармоническими в области D , непрерывными на \bar{D} и $u \geq v$ на Γ , то $u \geq v$ в D .

Следствие 4. Если функция $u(x)$ является гармонической в D и непрерывной на замкнутой области \bar{D} , то при любых $x \in \bar{D}$ справедливы оценки:

$$a) \min_{\Gamma} u(x) \leq u(x) \leq \max_{\Gamma} u(x); \quad б) |u(x)| \leq \max_{\Gamma} |u(x)|.$$

Следствие 5. Если последовательность гармонических в области D и непрерывных в замкнутой области \bar{D} функций сходится равномерно на границе Γ области D , то эта последовательность равномерно сходится и во всей замкнутой области \bar{D} .

Теорема 4 (Граничный принцип экстремума Зарембы [2]). Пусть:

1) функция $u(x)$ является гармонической в D , непрерывной на замкнутой области \bar{D} и отличной от постоянной;

2) граница Γ области D удовлетворяет условию строгой сферичности изнутри¹

$$3) \max_{\bar{D}} u(x) = u(x_0), \quad (\min_{\bar{D}} u(x) = u(x_0)), \quad x_0 \in \Gamma.$$

Тогда, если в точке $x = x_0$ существует производная по внешней нормали N к границе Γ области D , то

$$\frac{\partial u}{\partial N} \Big|_{x=x_0} > 0 \quad (< 0).$$

Доказательство теорем 3 и 4 приводится в [3, с. 126 – 131; с. 149 – 153].

Рассмотрим две известные классические задачи.

Задача Дирихле. Найти в области D решение $u(x)$ уравнения (7), непрерывное в \bar{D} и удовлетворяющее граничному условию

$$u(x)|_{\Gamma} = f(x), \quad x \in \Gamma, \quad (8)$$

где f – заданная, по крайней мере, непрерывная функция.

¹Граница Γ области $D \subset \mathbb{R}^n$, $n \geq 2$, удовлетворяет условию строгой сферичности изнутри, если для каждой точки $y \in \Gamma$ можно коснуться шаром B , целиком лежащим в D , т. е. существует шар B , такой, что $\bar{B} \cap \Gamma = \{y\}$, $B \subset D$. Данное геометрическое условие выполняется, если поверхность $\Gamma \in C^2$.

Теорема 5. *Если существует решение задачи Дирихле для уравнения Лапласа, т. е. задачи (7), (8), то оно единственно и устойчиво.*

Доказательство. Допустим, что существует две функции $u_1(x)$ и $u_2(x)$, удовлетворяющих всем условиям задачи Дирихле. Рассмотрим разность этих функций $u(x) = u_1(x) - u_2(x)$. Функция $u(x)$ удовлетворяет следующим условиям:

- 1) $u(x) \in C(\overline{D}) \cap C^2(D)$;
- 2) $\Delta u(x) = \Delta(u_1(x) - u_2(x)) = \Delta u_1(x) - \Delta u_2(x) \equiv 0$ в D ;
- 3) $u(x)|_{\Gamma} = [u_1(x) - u_2(x)]|_{\Gamma} = u_1(x)|_{\Gamma} - u_2(x)|_{\Gamma} = f(x) - f(x) \equiv 0$.

Значит, функция $u(x)$ является гармонической в области D , непрерывной в замкнутой области \overline{D} и $u(x)|_{\Gamma} = 0$. По доказанному выше принципу экстремума, $\max_{\overline{D}} u$ и $\min_{\overline{D}} u$ достигаются на границе Γ , а на Γ функция $u(x) = 0$. Тогда $u(x) \equiv 0$ в \overline{D} , т. е. $u_1(x) = u_2(x)$.

Пусть $u_1(x)$ – решение задачи (7), (8) при граничной функции $f_1(x)$, а $u_2(x)$ – решение задачи (7), (8) при функции $f_2(x)$. Тогда разность $u_1(x) - u_2(x)$ является решением задачи (7), (8) с граничной функцией $f_1(x) - f_2(x)$. Пусть для любого $\varepsilon > 0$ и при всяком $x \in \Gamma$ справедливо неравенство $|f_1(x) - f_2(x)| < \varepsilon$. Тогда в силу следствия 4 для разности $u_1(x) - u_2(x)$ справедлива оценка

$$|u_1(x) - u_2(x)| \leq \max_{\Gamma} |u_1(x) - u_2(x)| = \max_{\Gamma} |f_1(x) - f_2(x)| < \varepsilon.$$

А это означает устойчивость решения задачи Дирихле для уравнения Лапласа.

Задача Неймана. *Найти в области D решение $u(x)$ уравнения (7) из класса $C^1(\overline{D})$, удовлетворяющее гранично-*

му условию

$$\frac{\partial u}{\partial N} \Big|_{\Gamma} = g(x), \quad (9)$$

где $g(x)$ – заданная, по крайней мере, непрерывная функция.

Теорема 6. Если существует решение задачи Неймана, т. е. задачи (7) и (9), то оно определяется с точностью до постоянного слагаемого.

Доказательство. Пусть существует два решения $u_1(x)$ и $u_2(x)$ задачи Неймана. Рассмотрим их разность $u(x) = u_1(x) - u_2(x)$, которая принадлежит классу $C^1(\overline{D}) \cap C^2(D)$, является гармонической в области D и на Γ удовлетворяет однородному граничному условию

$$\frac{\partial u}{\partial N} \Big|_{\Gamma} = \frac{\partial(u_1 - u_2)}{\partial N} \Big|_{\Gamma} = \frac{\partial u_1}{\partial N} \Big|_{\Gamma} - \frac{\partial u_2}{\partial N} \Big|_{\Gamma} = g(x) - g(x) = 0.$$

Пусть функция $u(x)$ тождественно не равна постоянной в области D . Поскольку $u(x) \in C(\overline{D})$, то существуют точки $x_1, x_2 \in \overline{D}$, такие, что $u(x_1) = \max_{\overline{D}} u(x)$, $u(x_2) = \min_{\overline{D}} u(x)$. В силу строгого внутреннего принципа экстремума для гармонических функций $x_1, x_2 \notin D$ и $x_1, x_2 \in \Gamma$. На основании граничного принципа экстремума

$$\frac{\partial u}{\partial N} \Big|_{x=x_1} > 0 \quad \text{и} \quad \frac{\partial u}{\partial N} \Big|_{x=x_2} < 0.$$

Последние неравенства противоречат граничному условию $\frac{\partial u}{\partial N} \Big|_{\Gamma} = 0$. Следовательно, $u(x) \equiv \text{const}$ в D , т. е. $u_1(x) = u_2(x) + \text{const}$.

Рассмотрим примеры из студенческих олимпиад.

Пример 4. Пусть функция $u(x)$ является гармонической в области D , непрерывной в замкнутой области $\overline{D} = D \cup \Gamma$ и $u|_{\Gamma} = \text{const}$. Тогда чему равна функция $u(x)$ внутри области D ?

Пример 5. Пусть комплексная функция $f(z)$ аналитична в области D и непрерывна на $\bar{D} = D \cup \Gamma$. Доказать, что $f(z) \equiv \text{const}$ в D , если $\text{Im}f(z) = \text{const}$ или $\text{Re}f(z) = \text{const}$ на Γ .

§3. Линейные эллиптические уравнения общего вида

Рассмотрим дифференциальное уравнение в частных производных 2-го порядка

$$Lu \equiv \sum_{i,j=1}^n a_{ij}(x) \frac{\partial^2 u}{\partial x_i \partial x_j} + \sum_{i=1}^n b_i(x) \frac{\partial u}{\partial x_i} + c(x)u = f(x) \quad (10)$$

в ограниченной области $D \subset \mathbb{R}^n$, $n \geq 2$, с границей Γ , где $a_{ij}(x)$, $b_i(x)$, $c(x)$ и $f(x)$ заданы и непрерывны в \bar{D} , при этом $a_{ij}(x) = a_{ji}(x)$ для любого $x \in D$.

Пусть для любого $x \in D$ соответствующая квадратичная форма при любом $t = (t_1, t_2, \dots, t_n) \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$

$$Q(t_1, t_2, \dots, t_n) = \sum_{i,j=1}^n a_{ij}(x) t_i t_j > 0. \quad (11)$$

Условие (11) означает, что уравнение (10) в области D является эллиптическим.

Теорема 7 (Внутренний принцип экстремума).

Пусть

1) всюду в D

$$c(x) < 0 \quad \text{и} \quad f(x) \geq 0 \quad (\leq 0) \quad (12)$$

или

$$c(x) \leq 0 \quad \text{и} \quad f(x) > 0 \quad (< 0); \quad (13)$$

2) $u(x) \in C(\bar{D}) \cap C^2(D)$ и $Lu \equiv f(x)$ в D .

Тогда функция $u(x)$ ни в одной точке области D не может достигать положительного локального максимума (отрицательного локального минимума), следовательно, наибольшее в \bar{D} положительное значение (наименьшее в \bar{D} отрицательное значение) достигается только на границе Γ области D .

Естественно возникает вопрос: нельзя ли объединить условия (12) и (13) в одно:

$$c(x) \geq 0 \quad \text{и} \quad f(x) \geq 0 \quad (\leq 0).$$

Для этого введем понятие равномерной эллиптичности оператора L (см. (10)).

Определение 2. Уравнение (10) или оператор L называется равномерно эллиптическим в области D , если существуют положительные постоянные k_0 и k_1 , такие, что для всех $x \in D$ выполняется оценка

$$k_0|t|^2 \leq Q(t_1, t_2, \dots, t_n) \leq k_1|t|^2. \quad (14)$$

где $|t| = \sqrt{t_1^2 + t_2^2 + \dots + t_n^2}$ — расстояние от центра $\bar{0}$ до точки t пространства \mathbb{R}^n .

Уравнение Лапласа (7) во всем пространстве \mathbb{R}^n является равномерно эллиптическим, так как $Q(t_1, t_2, \dots, t_n) = |t|^2$, и в оценке (14) в качестве k_0 и k_1 можно взять $k_0 = k_1 = 1$ или $k_0 = 1/2$, $k_1 = 1$.

Определение 3. Под регулярным в области D решением уравнения (10) будем понимать функцию $u(x)$, удовлетворяющую условиям: $u(x) \in C(\bar{D}) \cap C^2(D)$ и $Lu(x) \equiv f(x)$ в D .

Теорема 8 (Принцип Хопфа – Олейник [4, 5]). Пусть:

1) оператор L является равномерно эллиптическим в D

и

$$c(x) \leq 0 \quad \text{и} \quad f(x) \geq 0 \quad (\leq 0) \quad \text{в } D;$$

2) $u(x)$ – регулярное в D решение уравнения (10).

Тогда функция $u(x)$ ни в одной точке области D не может достигать положительного локального максимума (отрицательного локального минимума), если она не обращается в постоянную в любой подобласти области D .

Теорема 9 (Граничный принцип Жиро – Олейник [6, 4]). Пусть:

1) выполнено условие 1) теоремы 8;

2) $u(x)$ – регулярное в D решение уравнения (10), непрерывное вплоть до границы области D со своими частными производными первого порядка и $u(x) \neq \text{const}$ в любой подобласти области D ;

3) граница Гамма области D удовлетворяет условию строгой сферичности изнутри;

4) $\max_{\overline{D}} u(x) = u(x_0) > 0$ ($\min_{\overline{D}} u(x) = u(x_0) < 0$), $x_0 \in \Gamma$.

Тогда для любого направления l , исходящего из точки x_0 и удовлетворяющего условию $\cos(l, N) > 0$, имеет место неравенство

$$\frac{\partial u(x_0)}{\partial l} > 0 \quad (< 0).$$

Доказательство теорем 7 – 9 можно найти в работах самих авторов [4 – 6] или монографии [7, с. 28 – 32].

На основании теорем 7 – 9 можно доказать теоремы единственности решений задач Дирихле, Неймана и Пуанкаре для уравнения (10) в области D .

Естественно возникает вопрос о справедливости теоремы 9, когда не выполняется условие 3) этой теоремы.

Рассмотрим уравнение (10) в области D с угловой точкой y (см. рис. 3).

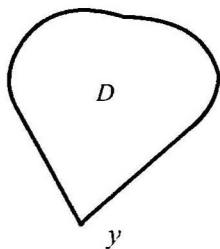


Рис. 3

Теорема 10 (Граничный принцип Надирашвили [8]).

Пусть: выполнены условия 1), 2) и 4) теоремы 9; граница Γ области D удовлетворяет условию конусности изнутри². Тогда в любой окрестности $\Omega \subset \Gamma$ точки x_0 найдется точка $x' \in \Omega$, такая, что

$$\left. \frac{\partial u}{\partial \nu} \right|_{x=x'} > 0 \quad (< 0).$$

Теорема 11 [9]. Пусть:

1) выполнены все условия теоремы 10 за исключением того, что эллиптический оператор L не обязательно является равномерно эллиптическим в D (т. е. уравнение (10) может быть вырождающимся в \bar{D});

$$2) \sum_{i=1}^n b_{ix_i} \geq K \cdot c(x) \text{ в } D;$$

3) на границе Γ в проколотой окрестности угловой точки y : $\sum_{i=1}^n n_i b_i \leq 0$, где n_i – компоненты вектора внешней нормали к $\Gamma \setminus \{y\}$ и $K = \text{const} > 0$.

²Граница Γ удовлетворяет условию конусности изнутри, если существуют постоянные $h > 0$, $\alpha \in (0, 1/2)$ и непрерывное векторное поле $v(x)$ на Γ , такие, что для любой точки $y \in \Gamma$ конус с вершиной в точке y высоты h , углом раствора 2α и осью, направленной по $v(x)$ целиком, кроме вершины, лежит в D . В частности, условие конуса выполнено, когда $\Gamma \in C^1$, т. е. для областей с липшицевой границей Γ

Тогда справедливо заключение теоремы Надираливили.

Если в уравнении (10) $b_i(x) \equiv 0$, то условия теоремы 11 всегда выполнены. Отметим также, что теорема 11 находит применение в теории вырождающихся уравнений смешанного типа.

Замечание 1. Аналогии теорем 7 – 9 получены для уравнений параболического типа, в частности, для уравнения теплопроводности [3, с. 180 – 183], [10].

§4. Принцип экстремума решений уравнений гиперболического типа

Рассмотрим уравнение гиперболического типа

$$L_0 u \equiv u_{\xi\eta} + a(\xi, \eta)u_{\xi} + b(\xi, \eta)u_{\eta} + c(\xi, \eta)u = f(\xi, \eta) \quad (15)$$

в характеристическом треугольнике Δ (см. рис. 4), ограниченном отрезками прямых $\xi = 0$, $\eta = \xi$ и $\eta = l$.

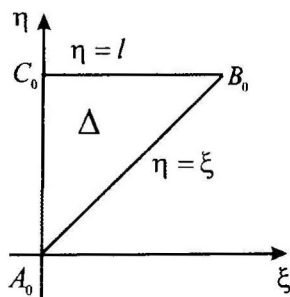


Рис. 4

Пусть $A_0 = (0, 0)$, $B_0 = (l, l)$, $C_0 = (0, l)$ – вершины треугольника Δ ; $\alpha(\xi, \eta) = a(\xi, \eta)\beta(\xi, \eta)$, $\beta(\xi, \eta) = \exp \int b(\xi, \eta)d\xi$, $h(\xi, \eta) = a_{\xi}(\xi, \eta) + a(\xi, \eta)b(\xi, \eta) - c(\xi, \eta)$.

Пусть функции $a(\xi, \eta)$, $a_\xi(\xi, \eta)$, $b(\xi, \eta)$ и $c(\xi, \eta)$ непрерывны в $\Delta \cup A_0C_0$ и при $(\xi, \eta) \in \Delta$ удовлетворяют одному из следующих условий:

$$\begin{cases} h(\xi, \eta) \geq 0, \\ \alpha(0, \eta) + \int_0^\xi \beta(t, \eta)c(t, \eta)dt > 0; \end{cases} \quad (16)$$

$$\alpha(\xi, \eta) - \int_0^\xi \beta(t, \eta)|h(t, \eta)|dt > 0. \quad (17)$$

Отметим, что в условиях (16) и (17) интегральные неравенства могут быть нестрогими (т. е. ≥ 0), но в этом случае на каждом отрезке $[0, \xi]$ характеристики $\eta = \text{const}$ множество точек, в которых $h(t, \eta) = 0$, имеет меру нуль.

Предполагается, что правая часть $f(\xi, \eta)$ интегрируема по ξ на каждом отрезке $[0, \xi_0]$ характеристики $\eta = \eta_0$, $0 < \xi_0 < \eta_0 < l$.

Определение 4. Регулярным решением уравнения (15) в области Δ назовем функцию $u(\xi, \eta)$, удовлетворяющую условиям:

- 1) $u \in C(\overline{\Delta}) \wedge C^1(\Delta)$, $u_{\xi\eta} \in C(\Delta)$, $L_0u \equiv f$ в Δ ;
- 2) производная u_η непрерывна на множестве $\Delta \cup A_0C_0$.

Теорема 12 (Принцип экстремума). Пусть:

- 1) коэффициенты уравнения (15) обладают отмеченной выше гладкостью и удовлетворяют условию (16);
- 2) $f(\xi, \eta) \leq 0$ (≥ 0) в Δ ;
- 3) $u(\xi, \eta)$ регулярное в Δ решение уравнения (15), равное нулю на характеристике A_0C_0 .

Тогда, если $\max_{\overline{\Delta}} u(\xi, \eta) > 0$ ($\min_{\overline{\Delta}} u(\xi, \eta) < 0$), то $\max_{\overline{\Delta}} u$ ($\min_{\overline{\Delta}} u$) достигается на отрезке $\overline{A_0B_0}$.

Теорема 13 (Принцип максимума модуля). Пусть:

1) коэффициенты уравнения (15) обладают отмеченной выше гладкостью и удовлетворяют условию (17);

2) $f(\xi, \eta) \equiv 0$ в Δ ;

3) $u(\xi, \eta)$ – регулярное решение уравнения (15), равное нулю на характеристике $\overline{A_0 C_0}$.

Тогда, если $\max_{\Delta} |u(\xi, \eta)| > 0$, то он достигается на отрезке $\overline{A_0 B_0}$.

Доказательство теорем 12 и 13 приведены в работе [11].

Замечание 2. Принцип экстремума для уравнения (15) впервые был установлен в [12] при условиях: $u_\eta(0, \eta) \leq 0$ (≥ 0), $u \in C^1(\overline{\Delta}) \cap C^2(\Delta)$, $L_0 u \leq 0$ (≥ 0) в $\overline{\Delta} \setminus \overline{A_0 B_0}$; $a, a_\xi, b, c \in C(\overline{\Delta})$; $a \geq 0, h \geq 0, c \geq 0$ в $\overline{\Delta}$.

§5. Принцип экстремума для уравнений смешанного типа

В теории уравнений смешанного типа первой граничной задачей является, так называемая, задача Трикоми по имени итальянского математика. Ф. Трикоми ставил свою задачу для уравнения

$$yu_{xx} + u_{yy} = 0.$$

Ф.И. Франкль впервые обнаружил весьма важные приложения задачи Трикоми для уравнения Чаплыгина

$$K(y)u_{xx} + u_{yy} = 0,$$

где $K(0) = 0$, $K'(y) > 0$, и других родственных ей задач в газовой динамике — в теории установившихся околосзвуковых течений. Для простоты изложения здесь рассмотрим задачу

Трикоми для модельного уравнения смешанного типа

$$u_{xx} + \operatorname{sgn} y \cdot u_{yy} = 0,$$

которое для упрощения исследования граничных задач для уравнений смешанного типа было предложено М.А. Лаврентьевым. Детальное исследование задачи Трикоми и ее различных обобщений для данного уравнения провел А.В. Бицадзе.

Рассмотрим уравнение Лаврентьева – Бицадзе

$$Lu \equiv u_{xx} + \operatorname{sgn} y \cdot u_{yy} = 0 \quad (18)$$

в области D , ограниченной кусочно-гладкой кривой Γ , лежащей в полуплоскости $y > 0$ с концами в точках $A(0,0)$ и $B(1,0)$, и характеристиками $AC(x+y=0)$ и $CB(x-y=1)$ уравнения (18) при $y < 0$. (см. рис. 5).

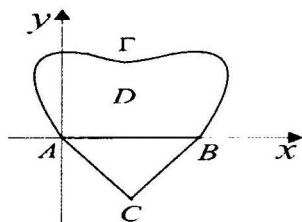


Рис. 5

Обозначим через $D_+ = D \cap \{y > 0\}$, $D_- = D \cap \{y < 0\}$.

Задача Трикоми (Задача Т). Найти в области D функцию $u(x, y)$, удовлетворяющую условиям:

$$u(x, y) \in C(\overline{D}) \cap C^1(D) \cap C^2(D_+ \cup D_-); \quad (19)$$

$$Lu(x, y) \equiv 0, \quad (x, y) \in D_+ \cup D_-; \quad (20)$$

$$u(x, y)|_{\Gamma} = \varphi(x, y), \quad (x, y) \in \Gamma; \quad (21)$$

$$u(x, y)|_{AC} = u(x, -x) = \psi(x), \quad 0 \leq x \leq 1/2, \quad (22)$$

где $\varphi(x, y)$ и $\psi(x)$ — заданные достаточно гладкие функции, причем $\varphi(0, 0) = \psi(0)$.

Отметим, что из условия (19) следует, что

$$\lim_{y \rightarrow 0-0} u(x, y) = \lim_{y \rightarrow 0+0} u(x, y), \quad 0 \leq x \leq 1; \quad (23)$$

$$\lim_{y \rightarrow 0-0} u_y(x, y) = \lim_{y \rightarrow 0+0} u_y(x, y), \quad 0 < x < 1 \quad (24)$$

или

$$u(x, 0-0) = u(x, 0+0) = \tau(x), \quad 0 \leq x \leq 1; \quad (25)$$

$$u_y(x, 0-0) = u_y(x, 0+0) = \nu(x), \quad 0 < x < 1. \quad (26)$$

Условия (23) и (24) или (25) и (26) называются условиями склеивания или сопряжения. Линия $y = 0$ называется линией перехода или линией изменения типа уравнения (18). На этой линии не требуется выполнения уравнения (18).

Теорема 14 (Принцип экстремума А.В. Бицадзе [13]). Если функция $u(x, y)$ удовлетворяет условиям (19), (20) и $u(x, y) = 0$ на характеристике AC , то $\max_{\bar{D}} u(x, y)$ ($\max_{\bar{D}} u(x, y)$) достигается на кривой $\bar{\Gamma}$.

Доказательство. Пусть $u(x, y)$ достигает глобального максимума по \bar{D} в некоторой точке $Q \in \bar{D}$, т. е. $\max_{\bar{D}} u(x, y) = u(Q)$, $Q \in \bar{D}$. Надо доказать, что $Q \in \Gamma$.

В области D_+ функция $u(x, y)$ является гармонической. Тогда в силу внутреннего принципа экстремума для гармонических функций точка $Q \notin D_+$, если $u(x, y) \neq \text{const}$ в D_+ , т. е. $Q \in \bar{\Gamma} \cup AB$. Пусть точка $Q \in AB$, тогда $Q = (x_0, 0)$, $0 < x_0 < 1$. В области D_- для уравнения (18), т. е. уравнения струны

$$u_{xx} - u_{yy} = 0 \quad (27)$$

рассмотрим задачу Дарбу с данными: $u(x, 0-0) = \tau(x)$, $0 \leq x \leq 1$; $u|_{AC} = u(x, -x) = 0$, $0 \leq x \leq 1/2$, где $\tau(0) = 0$, $\tau(x)$ – заданная функция. Как известно, если $\tau(x) \in C[0, 1] \cap C^2(0, 1)$, $\tau(0) = 0$, то решение задачи Дарбу для уравнения (27) определяется формулой

$$u(x, y) = \tau(x + y). \quad (28)$$

Отсюда видно, что (см. рис. 6)

$$\max_{\overline{D_-}} u(x, y) = \max_{\overline{AB}} u(x, y) = \max_{0 \leq t \leq 1} \tau(t).$$

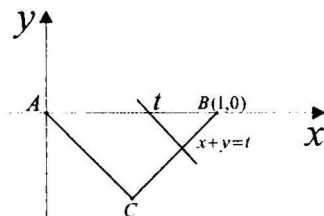


Рис. 6

Из формулы (28) вычислим $u_y(x, 0-0) = \tau'(x)$. Тогда в точке $(x_0, 0)$

$$u_y(x_0, 0-0) = \tau'(x_0) = 0. \quad (29)$$

С другой стороны, в силу граничного принципа экстремума для гармонических функций $u_y(x_0, 0+0) < 0$, что на основании равенства (26) противоречит (29). Следовательно, точка $Q \notin AB$, и остается случай, когда $Q \in \overline{\Gamma}$. Если $u(x, y) \equiv C_0 = \text{const}$ в D_+ , то $u(x, y) \equiv C_0$ на \overline{D} . Поскольку $u(x, y) \in C(\overline{D})$ и $u = 0$ на AC , то $C_0 = 0$. Следовательно, это значение достигается всюду на \overline{D} , в частности на границе $\overline{\Gamma}$.

Следствие 6. Пусть выполнены условия теоремы 14. Тогда для любых $(x, y) \in \overline{D}$ справедливы оценки:

$$а) \min_{\bar{\Gamma}} u(x, y) \leq u(x, y) \leq \max_{\bar{\Gamma}} u(x, y),$$

$$б) |u(x, y)| \leq \max_{\bar{\Gamma}} |u(x, y)|.$$

Следствие 7. Пусть выполнены условия теоремы 14. Тогда если $u(x, y) \geq 0$ (≤ 0) на Γ , то $u(x, y) \geq 0$ (≤ 0) в \bar{D} .

Доказательство. Пусть существует точка $Q_1 \in D$, такая, что $u(Q_1) < 0$. Тогда $\min_{\bar{D}} u(x, y) = u(Q_0) < 0$. По теореме 14 точка $Q_0 \in \Gamma$, что противоречит условию $u \geq 0$ на Γ .

Теорема 15. Если существует решение задачи (19) – (22), то оно единственно.

Доказательство следует из принципа экстремума. Пусть существуют два решения $u_1(x, t)$ и $u_2(x, t)$ задачи (19) – (22). Тогда их разность $u(x, t) = u_1(x, t) - u_2(x, t)$ удовлетворяет условиям (19), (20) и

$$u(x, y)|_{AC} = u_1(x, y)|_{AC} - u_2(x, y)|_{AC} = \psi(x) - \psi(x) \equiv 0,$$

$$u(x, y)|_{\Gamma} = u_1(x, y)|_{\Gamma} - u_2(x, y)|_{\Gamma} = \varphi(x, y) - \varphi(x, y) \equiv 0.$$

Поскольку для разности $u(x, y)$ выполнены все условия теоремы 14, то $\max_{\bar{D}} u(x, y)$ и $\min_{\bar{D}} u(x, y)$ достигаются на кривой $\bar{\Gamma}$, а там $u(x, y) = 0$. Следовательно, $u(x, y) \equiv 0$ на \bar{D} , т. е. $u_1(x, t) \equiv u_2(x, t)$.

Теперь рассмотрим линейное уравнение смешанного типа общего вида, т. е. уравнение

$$Lu \equiv K(y)u_{xx} + u_{yy} + Au_x + Bu_y + Cu = F, \quad (30)$$

где $yK(y) > 0$ при $y \neq 0$, $K(y), A(x, y), B(x, y), C(x, y), F(x, y)$ – заданные достаточно-гладкие функции, в области D (см. рис. 7), ограниченной простой кривой Жордана Γ , лежащей

в полуплоскости $y > 0$ с концами в точках $A = (0, 0)$ и $B = (l, 0)$, $l > 0$ и характеристиками

$$AC : \xi = x + \int_0^y \sqrt{-K(t)} dt = 0, \quad CB : \eta = x - \int_0^y \sqrt{-K(t)} dt = l,$$

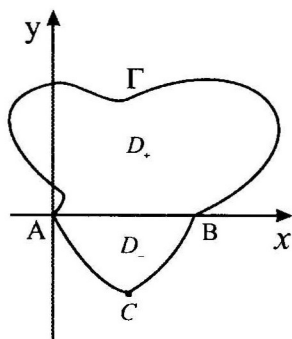


Рис. 7

где $K(y) \in C[y_c, 0] \cap C^2[y_c, 0[$, y_c — ордината точки C уравнения (30), при $y < 0$, и следующую краевую задачу.

Задача Трикоми (Задача Т). Найти функцию $u(x, y)$, удовлетворяющую условиям:

$$u(x, y) \in C(\overline{D}) \cap C^1(D) \cap C^2(D_+ \cup D_-); \quad (31)$$

$$Lu(x, y) \equiv F(x, y), \quad (x, y) \in D_+ \cup D_-; \quad (32)$$

$$u(x, y) = \varphi(x, y), \quad (x, y) \in \Gamma; \quad (33)$$

$$u(x, y) = \psi(x, y), \quad (x, y) \in AC, \quad (34)$$

где φ и ψ — заданные достаточно гладкие функции, $\varphi(A) = \psi(A)$, $D_+ = D \cap \{y > 0\}$, $D_- = D \cap \{y < 0\}$.

При исследовании задачи Т и других аналогичных краевых задач важную роль играет принцип экстремума. Впервые

принцип экстремума был сформулирован в 1950 году А.В. Бицадзе [13] для уравнения (30) при $K(y) = \operatorname{sgn} y$, $A = B = C = F \equiv 0$ (см. выше теорему 14). На год позже этот принцип был получен в работе Жермеса и Бадера [14] для уравнения Трикоми, т. е. для уравнения (30) при $K(y) = y$, $A = B = C = F \equiv 0$.

В 1952 году в своей диссертации К.И. Бабенко [15] доказал справедливость принципа экстремума для уравнения (30) в некотором классе его обобщенных решений при $K(y) = y$, $A(x, 0) = B(x, 0) = 0$, $F(x, y) \equiv 0$ и достаточно малой длине линии изменения типа уравнения.

В 1953 году в работе Агмона, Ниренберга и Проттера [12] был установлен принцип экстремума для гиперболических уравнений и на его основе принцип экстремума для уравнения (30) при достаточно сильных ограничениях на коэффициенты в области гиперболичности и класс решений.

Дальнейшие исследования в этом направлении велись С.С. Мораветц [16], С.П. Пулькиным [17, 18], В.Ф. Волкодатовым [19 – 21], М.М. Смирновым [21], М.С. Салахитдиновым [22], И.В. Майоровым [23], Т.Д. Джураевым [23], [24] Ю.М. Крикуновым [26], М.Е. Лернером [28], К.В. Сабитовым [11] и другими математиками. В основном исследования проводились по двум направлениям:

- 1) установление принципа экстремума для общих уравнений смешанного типа с одной линией изменения типа с целью ослабления тех ограничений, которые возникли в работах К.И. Бабенко и Агмона, Ниренберга и Проттера;

- 2) установление принципа экстремума для исследования задачи Т и других аналогичных краевых задач для известных модельных уравнений смешанного и смешанно-составного типов

с одной или несколькими линиями изменения типа.

Лемма 1. Пусть: 1) в области D_+ коэффициенты уравнения (30) ограничены и $C(x, y) \leq 0$; 2) $u(x, y) \in C(\overline{D}_+) \cap C^1(D_+ \cup AB) \cap C^2(D_+)$ и $Lu \equiv F \geq 0$ (≤ 0) в D_+ ; 3) $\max_{\overline{D}_+} u(x, y) = u(x_0, 0) > 0$ ($\min_{\overline{D}_+} u(x, y) = u(x_0, 0) < 0$), $0 < x_0 < l$. Тогда

$$\lim_{y \rightarrow 0+0} u_y(x_0, y) = u_y(x_0, 0+0) < 0 \quad (> 0).$$

Определение 4. Регулярным в области D решением уравнения (30) назовем функцию $u(x, y)$, удовлетворяющую условиям (31) и (32), и, кроме того, $u_\eta \in C(\Delta \cup A_0 C_0)$.

Теорема 16. Пусть:

1) коэффициенты уравнения (30) в области D_+ ограничены и $C(x, y) \leq 0$;

2) коэффициенты уравнения (30) в области D_- в характеристических координатах (ξ, η) удовлетворяют условиям теоремы 12;

3) $F(x, y) \geq 0$ (≤ 0) на $D_+ \cup D_-$; 4) $u(x, y)$ регулярное в D решение уравнения (30), равное нулю на характеристике AC .

Тогда, если $\max_{\overline{D}} u(x, y) > 0$ ($\min_{\overline{D}} u(x, y) < 0$), то $\max_{\overline{D}} u$ ($\min_{\overline{D}} u$) достигается на кривой $\overline{\Gamma}$.

Теорема 17. Пусть:

1) коэффициенты уравнения (30) в области D_+ ограничены и $C(x, y) \leq 0$;

2) коэффициенты уравнения (30) в области D_- в характеристических координатах (ξ, η) удовлетворяют условиям теоремы 13;

3) $F(x, y) \equiv 0$; 4) $u(x, y)$ – регулярное в D решение уравнения (30), равное нулю на характеристике AC .

Тогда, если $\max_{\overline{D}} |u(x, y)| > 0$, то этот максимум достигается на дуге $\overline{\Gamma}$.

Следствие 8. а) Если выполнены условия теоремы 16 и $F(x, y) \equiv 0$, то для любой точки $(x, y) \in \overline{D}$ справедлива оценка

$$\min_{\Gamma} u(x, y) \leq u(x, y) \leq \max_{\Gamma} u(x, y).$$

б) Если выполнены условия теоремы 17, то для любой точки $(x, y) \in \overline{D}$

$$|u(x, y)| \leq \max_{\overline{\Gamma}} |u(x, y)|.$$

в) Если коэффициенты уравнения (30) удовлетворяют условиям теоремы 16 или 17 и в классе регулярных в D решений уравнения (30) существует решение задачи (31) – (34), то оно единственно.

Следствие 9. Пусть: 1) коэффициенты уравнения (30) удовлетворяют условиям 1) и 2) теоремы 16; 2) $F(x, y) \leq 0$ ($F(x, y) \geq 0$) на $D_+ \cup D_-$; 3) $u(x, y)$ – регулярное решение уравнения (30), равное нулю на AC . Тогда

1) если $u \geq 0$ (≤ 0) на $\overline{\Gamma}$, то $u \geq 0$ (≤ 0) в \overline{D}

2) если $u > 0$ (< 0) на Γ , то $u \geq 0$ (≤ 0) в \overline{D} и $u > 0$ (< 0) в D_+ .

ЛИТЕРАТУРА

1. Сабитов К.Б. Функциональные, дифференциальные и интегральные уравнения. – М.: Высшая школа, 2005. – 671 с.

2. Zaremba S. Sur une probleme toujours possible comprenant, a titre de cas particuliers, le probleme de Dirichlet et de Neumann // J. Math. Pures Appl. – 1927. – V.6. – P. 127–163.

3. Сабитов К.Б. *Уравнения математической физики*. – М.: Высшая школа, 2003. – 255 с.
4. Олейник О.А. *О свойствах решений некоторых краевых задач для уравнений эллиптического типа* // Матем. сб. – 1952. – Т. 30 (72). – №3. – С. 695–702.
5. Hopf E.A. *A remark on linear elliptic differential equations of second order* // Proc. Amer. Math. Soc. – 1952. – V. 3. – P. 791–793.
6. Giraud G. *Generalisation des problemes sur le operations du type elliptique* // Bull. Math. Soc. France. – 1932. – V. 56. – P. 316–352.
7. Бицадзе А.В. *Краевые задачи для эллиптических уравнений второго порядка*. – М.: Наука, 1966. – 203 с.
8. Надирашвили Н.С. *Лемма о внутренней производной и единственность решения 2-й краевой задачи для эллиптических уравнений второго порядка* // Докл. АН СССР. – 1981. – Т. 261. – № 4. – С. 804–808.
9. Сабитов К.Б., Мукминов Ф.Х. *О знаке производной по координатам в точке максимума решения вырождающихся эллиптических уравнений* // Дифференциальные уравнения. – 2000. – Т. 36. – № 6. – С. 938–942.
10. Nirenberg L. *A strong maximum principle for parabolic equations* // Comm. Pure and Appl. Math. – 1953. – V. 6. – No 2. – P. 167–177.
11. Сабитов К.Б. *О принципе максимума для уравнений смешанного типа* // Дифференциальные уравнения. – 1988. – Т. 24. – № 11. – С. 1967–1976.
12. Agmon S., Nirenberg L., Protter M.H. *A maximum principle for a class of hyperbolic equations and applications to equations of mixed elliptic-hyperbolic type* // Comm. Appl. Math.

– 1953. – V. 6. – No 4. – P. 455–470.

13. Бицадзе А.В. *О некоторых задачах смешанного типа* // Докл. АН СССР. – 1950. – Т. 70. – № 4. – С. 561–564.

14. Germain P., Bader R. *Sur le probleme de Tricomi* // Compt. Rend. Acad. Sci. Paris. – 1951. – V. 232. – P. 463–465.

15. Бабенко К.И. *К теории уравнений смешанного типа.* – Дис. ... д-ра физ.-мат. наук. – М., 1952.

16. Morawetz C.S. *Note on a maximum principle and a uniqueness theorem for on elliptic-hyperbolic equation* // Proc. Roy. Soc. – 1956. – V. 236. – No 1204. – P. 141–144.

17. Пулькин С.П. *О единственности решения сингулярной задачи Гильберта* // Изв. вузов. Математика. – 1960. – № 6 (19). – С. 214–225.

18. Пулькин С.П. *Исследование по уравнениям смешанного типа.* – Дис. ... д-ра физ.-мат. наук. – Казань: КГУ, 1958.

19. Волкодавов В.Ф., Невоструев Л.М. *Принцип локального экстремума для уравнения $yz_{xx} + zy_y + c(x, y)z = 0$ и его применения* // Волжск. матем. сб. – Куйбышев. – 1966. – Вып. 4. – С. 14–23.

20. Волкодавов В.Ф., Невоструев Л.М. *О принципе локального экстремума для уравнения Эйлера - Пуассона - Дарбу* // Волжск. матем. сб. – Куйбышев. – 1966. – Вып. 5. – С. 70–78.

21. Волкодавов В.Ф. *Принцип локального экстремума и его применение к решению краевых задач для дифференциальных уравнений с частными производными.* – Дис. ... д-ра физ.-мат. наук. – Казань: КГУ, 1969.

22. Protter M.H., Wienberger H.F. *Maximum principle in differential equations.* – Prentice-Hall. INC Englewood Cliffs. New-Jersey, 1967. – 261 p.

23. Смирнов М.М. *Уравнения смешанного типа*. – М.: Наука, 1970. – 296 с.
24. Майоров И.В. *О принципе экстремума для одной задачи Фраглья* // Сиб. матем. журн. – 1966. – Т. 7. – № 5. – С. 1068–1075.
25. Салахитдинов М.С. *Уравнения смешанно-составного типа*. – Ташкент: Фан, 1974. – 156 с.
26. Крикунов Ю.М. *К задаче Трикоми для уравнения Лаврентьева – Бицадзе* // Изв. вузов. Математика. – 1974. – № 2 (141). – С. 76–81.
27. Джурасв Т.Д. *Красвые задачи для уравнений смешанного и смешанно-составного типов*. – Ташкент: Фан, 1979. – 238 с.
28. Лернер М.Е. *Принципы максимума для уравнений гиперболического и смешанного типов в неклассических областях* // Докл. АН СССР. – 1986. – Т. 287. – № 3. – С. 550–554.